



【2024-04-03】

 中国央行今日开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率持平 1.8%。今日有 2500 亿元 7 天期逆回购到期。资金面整体偏松，7d repo fixing：2.0%，与上一交易日下降 10bp，3m shibor fixing:2.1430%，与上一交易日下降 0.8 个 bp。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.14%附近，后震荡成交在 2.135%-2.14%区间附近，午盘报收 13.75/13。中午回来，5y repo 区间内震荡，成交在 2.13%-2.1425%附近，报收 13.75/13.5。1y repo，震荡成交在 1.96%-1.975%区间附近，下午尾盘报收 96.75/96.5。其他期限，6m repo，成交在 2.015%附近，9m repo 成交在 1.985%附近。曲线方面，1x5 repo 成交在 17.25-17bp 附近，报收 17/16.75。

 Shibor 端，今日成交清淡，5y shibor 成交在 2.3075%附近，报收 31/30.25。基差方面，5y basis 成交在 17.25bp 附近，报收 17.5/17。其他方面，报价寥寥，未闻成交。

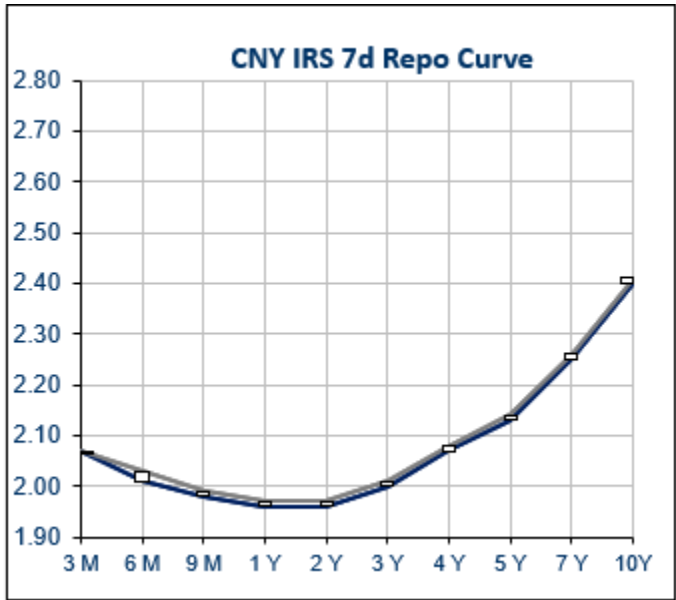
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/4/3 Wednesday

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365 (F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	2.07	-				3 M	1.72	-1						
6 M	2.01	-2	6 M	2.14	-1	6 M	1.75	-						
9 M	1.98	-1	9 M	2.11	-1	9 M	1.75	-						
1 Y	1.96	-1	1 Y	2.13	-1	1 Y	1.63	-				1Y	1.96	-1
2 Y	1.96	-1	2 Y	2.13	-1	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	-1
3 Y	2	-1	3 Y	2.16	-2	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.97	-1
4 Y	2.07	-1	4 Y	2.23	-2				4 Y	1.8	-	4Y	2.03	-1
5 Y	2.13	-1	5 Y	2.31	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.08	-2
7 Y	2.25	-1	7 Y	2.42	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.4	-1	10Y	2.52	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	-10.00	3M Shibor	2.143	-0.80	0-N Shibor	1.685	-1.90	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-6	-2			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3	1	-3	-				
9M*1Y	-2	-	2	-	6M	13	1	
1*2Y	0	-	0	-	9M	13	-	
1*3Y	4	-	3	-1	1Y	17	-	
1*4Y	11	-	10	-1	2Y	17	-	
1*5Y	17	-	18	-	3Y	16	-1	
2*3Y	4	-	3	-1	4Y	18	-	
2*4Y	11	-	10	-1	5Y	18	-	
2*5Y	17	-	18	-				
3*4Y	7	-	7	-				
3*5Y	13	-	15	1				
4*5Y	6	-	8	1				
5*7Y	12	-	11	-				
5*10Y	27	-	21	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	45	44	41	40	37	36	37
今日	45	44	41	40	37	36	37

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	5	24	11	35
今日	5	24	11	35



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting.bu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日报及更多资讯



免责声明:
以上所发及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国际货币经纪有限公司 (以下简称“上海国际货币”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资策略或任何交易策略相关的推介、定价、建议或诱导。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、及时性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改, 所有前述和保证均被明确放弃声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang